

关于申港证券睿泽 1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更投资者意见征询函（四）

尊敬的投资者：

申港证券股份有限公司（以下简称“我司”或“申港证券”）管理的“申港证券睿泽 1 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2021 年 6 月 4 日成立。根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案办法》等有关规定并结合本集合计划运作管理需要，经与托管人书面协商一致，拟变更部分合同条款。现根据《申港证券睿泽 1 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”之第（一）节“资产管理合同变更的条件和程序”之第 1、2 条约定：

“1、由于其他原因需要变更资产管理合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并由管理人以指定网站公告方式或书面等形式通知投资者。投资者应在征询期间内给出书面或其他约定方式的答复。投资者不同意变更的，应当在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部本集合计划份额；投资者答复不同意变更且在管理人指定的期限未退出的，管理人有权在指定的期限交易时间届满后将相关份额强制退出本集合计划；征询期限届满未有意见答复且在管理人指定的期限内未申请退出其持有的全部本集合计划份额的，视为同意资产管理合同变更，管理人不再另行通知。若前述指定期限与本集合计划开放期重合，则投资者在上述指定期限内根据资产管理合同约定参与集合计划的，视为同意资产管理合同变更并接受变更后的资产管理合同。资产管理合同变更自上述指定期限届满后次日或管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效。

2、因监管规则变化需要变更资产管理合同的，管理人可以与托管人书面协商一致后修改资产管理合同，并由管理人以指定网站公告的方式及时向投资者披露变更的具体内容。如投资者对变更的内容有异议，可以根据管理人的安排申请



退出本集合计划。”

一、变更对照明细表

1、对原合同第二章“释义”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
自有资金：指管理人参与本集合计划的资金	自有资金：指证券期货经营机构及其子公司参与本集合计划的资金

2、对原合同第五章“集合计划的基本情况”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（十）预警止损安排 根据本集合计划投资策略、潜在的收益波动水平、可能出现的最大回撤幅度等，本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线及止损线。 1、本集合计划的预警安排 本集合计划的预警线为【0.9500元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于预警线的，管理人应在计算出该净值并与托管人核对一致后的一个工作日内进行信息披露。 2、本集合计划的止损安排 本集合计划的止损线为【0.9200元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于止损线的，本集合计划终止，按照资产管理合同的约定组织清算集合计划资产。 托管人根据与管理人的估值核对	（十）预警止损安排 根据本集合计划投资策略、潜在的收益波动水平、可能出现的最大回撤幅度等，本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线及止损线。 1、本集合计划的预警安排 本集合计划的预警线为【0.9500元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于预警线，同时当且仅当T-1日本集合计划单位净值高于预警线的情况下，管理人将于T+1日内以管理人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和投资者认可的方式进行信息披露，持续等于或低于预警线管理人将不再另行披露。 特别示例如下： 假设本集合计划2024年8月14日单位净值高于预警线，2024年8月15日单位净值低于预警线，管理人将于

结果对预警、止损事项进行事后监督，托管人如若发现经核对的单位净值等于或低于预警线或止损线的，应当及时向管理人予以提示。 风险提示：本集合计划预警线和止损线的设置并不是管理人对投资者所能获得的集合计划最低单位净值的保证。	2024 年 8 月 16 日向投资者披露，若该情况持续至 2024 年 8 月 22 日，期间持续低于预警线的情况管理人不再另行披露；若后续运作期间单位净值再次升高回落至预警线，管理人将于 T+1 日内进行信息披露，持续等于或低于预警线期间不再另行披露，如此往复。特别提醒投资者在集合计划单位净值等于或低于预警线的情况下及时关注单位净值的波动。 2、本集合计划的止损安排 本集合计划的止损线为【0.9200 元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T 日）日终，本集合计划单位净值等于或低于止损线的，T+1 日本集合计划终止，按照资产管理合同的约定组织清算集合计划资产。 托管人根据与管理人的估值核对结果对预警、止损事项进行事后监督，托管人如若发现经核对的单位净值触及上述第 1、2 条所述情况的，应当及时向管理人予以提示。
---	--

3、对原合同第八章“集合计划的参与、退出与转让”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（七）参与份额和退出金额的计算方式 1、参与份额的计算方式 <u>净参与金额=参与金额/（1+参与费率）</u>	（七）参与份额和退出金额的计算方式 1、参与份额的计算方式 净参与金额=参与金额/（1+参与费率）

<u>参与费用=参与金额-净参与金额</u> 参与份额=<u>净参与金额</u>÷实际参与申请日集合计划份额净值 参与份额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。 2、退出金额的计算方式 <u>退出费用=退出份额×实际退出申请日集合计划份额净值×退出费率</u> 退出金额=退出份额×实际退出申请日集合计划份额净值-<u>退出费用</u>-业绩报酬（如有） 退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。 <u>退出费用全额归入集合计划财产。</u> <u>违约退出情形下的退出金额的计算方式由资产管理合同另行约定。</u>	<u>参与费用=参与金额-净参与金额</u> 参与份额=<u>净参与金额</u>÷参与申请日集合计划份额净值 参与份额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。 2、退出金额的计算方式 <u>退出费用=退出份额×退出申请日集合计划份额净值×退出费率</u> 退出金额=退出份额×退出申请日集合计划份额净值-<u>退出费用</u>-业绩报酬（如有） 退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。 <u>退出费用全额归入集合计划财产。</u>
（九）巨额退出的认定及处理方式 5、管理人可根据市场变化或集合计划运作情况对巨额退出或者连续巨额退出的认定标准进行调整。管理人应当提前1个工作日在指定网站公告调整方案。调整方案经过管理人指定网站公告后即生效，无需就该调整方案征求投	（九）巨额退出的认定及处理方式 5、管理人可根据市场变化或集合计划运作情况对巨额退出或者连续巨额退出的认定标准进行调整。管理人应当提前1个工作日在指定网站公告调整方案，履行告知投资者义务，调整方案生效时间以管理人指定网站公告为准。

资者意见。	
(十二) 违约退出 1、违约退出情形 违约退出适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。申请违约退出的投资者需提供情形说明及相关佐证材料，如投资者提供的说明及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，管理人有权拒绝办理投资者的违约退出申请。 2、违约退出的费用及违约退出金额的计算方式 (1) 违约退出费率为：0.05%。 (2) 违约退出金额的计算方式 违约退出费用=（违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-退出费（如有）-业绩报酬（如有））×违约退出费率 违约退出金额=违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-违约退出费用-退出费（如有）-业绩报酬（如有） 违约退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔违约退出时，按上述公式进行逐笔计算。 违约退出费用全额归入集合计划	(十二) 违约退出 1、违约退出情形 违约退出适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。申请违约退出的投资者需提供情形说明及相关佐证材料，如投资者提供的说明及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，管理人有权拒绝办理投资者的违约退出申请。 2、违约退出的费用及违约退出金额的计算方式 (1) 违约退出费率为：0.05%。 (2) 违约退出金额的计算方式 违约退出费用=（违约退出份额×违约退出申请日集合计划份额净值-退出费（如有）-业绩报酬（如有））×违约退出费率 违约退出金额=违约退出份额×违约退出申请日集合计划份额净值-违约退出费用-退出费（如有）-业绩报酬（如有） 违约退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔违约退出时，按上述公式进行逐笔计算。 违约退出费用全额归入集合计划

财产。	财产。
(十五) 管理人自有资金参与集合计划 1、自有资金参与的条件 管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按照《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东会、董事会或者其他授权程序的批准。 2、自有资金参与的方式和金额 在本集合计划初始募集期和存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本集合计划，参与金额不得低于本集合计划初始募集期最低参与金额限制（不含参与费用）。 3、自有资金参与和退出 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 50%。管理人以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 20%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。 在本集合计划初始募集期内，投资者和托管人在此同意并授权证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本集合计划。存续期内，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退	(十五) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划 1、自有资金参与的条件 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按照《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东会、董事会或者其他授权程序的批准。 2、自有资金参与的方式和金额 在本集合计划初始募集期和存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金认购或参与本集合计划，认购、参与金额不得低于本集合计划最低认购金额（不含认购费用）、最低参与金额限制（不含参与费用）。 3、自有资金参与和退出 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 50%。证券期货经营机构以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 20%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。 在本集合计划初始募集期内，投资者和托管人在此同意并授权证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金

出集合计划的，应当提前 5 个工作日以邮件形式或其他托管人认可的方式征询托管人，取得其同意，并通过征询公告或征询函形式征询全体投资者意见，其中投资者意见征询的方式具体为：

（1）证券期货经营机构及其子公司（如有）拟在开放期（含退出开放期）参与或退出的，通过公告方式征询投资者意见。管理人将保障不同意投资者的退出权利，不同意证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金参与、退出的投资者可在管理人指定的开放期内退出，未在管理人指定的开放期退出其持有全部份额及开放期参与的投资者视为同意证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金的参与、退出。

（2）证券期货经营机构及其子公司（如有）拟在仅开放参与的开放期参与的，通过事前征询函方式征询投资者意见，并区分全体投资者回复意见情况分别处理，若全体投资者均同意，则证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金可以在本次开放期内参与，且本次开放期不再开放退出；若未取得全体投资者同意（含投资者未答复的情况），则证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金将不在本次开放期内参与。

证券期货经营机构及其子公司（如

参与本集合计划。存续期内，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出集合计划的，应当提前 5 个工作日以邮件形式或其他托管人认可的方式征询托管人，取得其同意，并通过征询公告或征询函形式征询全体投资者意见，其中投资者意见征询的方式具体为：

（1）证券期货经营机构及其子公司（如有）拟在开放期（含退出开放期）参与或退出的，通过公告方式征询投资者意见。管理人将保障不同意投资者的退出权利，不同意证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金参与、退出的投资者可在管理人指定的开放期内退出，未在管理人指定的开放期退出其持有全部份额及开放期参与的投资者视为同意证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金的参与、退出。

（2）证券期货经营机构及其子公司（如有）拟在仅开放参与的开放期参与的，通过事前征询函方式征询投资者意见，并区分全体投资者回复意见情况分别处理，若全体投资者均同意，则证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金可以在本次开放期内参与，且本次开放期不再开放退出；若未取得全体投资者同意（含投资者未答复的情况），则证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金将不在本次开放期内参

有)自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。在满足最低持有时限,证券期货经营机构及其子公司在履行自有资金退出程序的基础上,可根据投资需要决策自有资金的退出。 因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动不符合相关监管规定或其预警值、合同约定的,不视为管理人违反此项约定,但在客观条件允许的情况下,管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定采取必要措施稳妥处置。前述被动超限情况的调整,无需提前5个工作日告知全体投资者和托管人并取得其同意,但应于调整后5个工作日内告知全体投资者和托管人。 为应对本集合计划巨额退出以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守资产管理合同约定的前提下,证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受上述限制,但应当及时告知投资者和托管人,并向中国证监会相关派出机构报告(如报备相关监管规定有变更,将按最新规定执行)。 4、自有资金的收益分配和风险承担 管理人自有资金持有的集合计划	与。 证券期货经营机构及其子公司(如有)自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。在满足最低持有时限,证券期货经营机构及其子公司在履行自有资金退出程序的基础上,可根据投资需要决策自有资金的退出。 因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动不符合相关监管规定或其预警值、合同约定的,不视为管理人违反此项约定,但在客观条件允许的情况下,管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定采取必要措施稳妥处置。前述被动超限情况的调整,无需提前5个工作日告知全体投资者和托管人并取得其同意,但应于调整后5个工作日内告知全体投资者和托管人。 为应对本集合计划巨额退出以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守资产管理合同约定的前提下,证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受上述限制,但应当及时告知投资者和托管人,并向中国证监会相关派出机构报告(如报备相关监管规定有变更,将按最新规定执行)。 4、自有资金的收益分配和风险承
---	---

份额与投资者持有的同类份额享有同等权益、承担同等风险。 5、风险揭示：证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注集合计划规模变动情况，控制风险。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断，亦不对本集合计划的同类份额本金或收益提供任何形式的保障。	担 证券期货经营机构及其子公司自有资金持有的集合计划份额与投资者持有的同类份额享有同等权益、承担同等风险。 5、风险揭示：证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注集合计划规模变动情况，控制风险。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断，亦不对本集合计划的同类份额本金或收益提供任何形式的保障。
---	--

4、对原合同第十八章“越权交易的界定”之“（三）托管人对管理人投资运作的监督”中新增以下表述，后续项目编号顺延：

新增表述： 4、预警止损安排 根据本集合计划投资策略、潜在的收益波动水平、可能出现的最大回撤幅度等，本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线及止损线。 （1）本集合计划的预警安排 本集合计划的预警线为【0.9500 元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T 日）日终，本集合计划单位净值等于或低于预警线，同时当且仅当 T-1 日本集合计划单位净值高于预警线的情况下，管理人将于 T+1 日内以管理人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和投资者认可的方式进行信息披露，持续等于或低于预警线管理人将不再另行披露。 特别示例如下：

假设本集合计划 2024 年 8 月 14 日单位净值高于预警线，2024 年 8 月 15 日单位净值低于预警线，管理人将于 2024 年 8 月 16 日向投资者披露，若该情况持续至 2024 年 8 月 22 日，期间持续低于预警线的情况管理人不再另行披露；若后续运作期间单位净值再次升高回落至预警线，管理人将于 T+1 日内进行信息披露，持续等于或低于预警线期间不再另行披露，如此往复。特别提醒投资者在集合计划单位净值等于或低于预警线的情况下及时关注单位净值的波动。

(2) 本集合计划的止损安排

本集合计划的止损线为【0.9200 元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T 日）日终，本集合计划单位净值等于或低于止损线的，T+1 日本集合计划终止，按照资产管理合同的约定组织清算集合计划资产。

托管人根据与管理人的估值核对结果对预警、止损事项进行事后监督，托管人如若发现经核对的单位净值触及上述第（1）（2）条所述情况的，应当及时向管理人予以提示。

5、对原合同第二十一章“集合计划的费用与税收”之“（一）集合计划的费用种类、费率、计提标准、计提方式与支付方式”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
2、管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3%年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.3\% \div \text{当年实际天数}$	2、管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.4%年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.4\% \div \text{当年实际天数}$

6、对原合同第二十一章“集合计划的费用与税收”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（三）管理人的业绩报酬 1、业绩报酬的计提原则及提取频率 （1）本集合计划将在两种情况下计提业绩报酬：	（三）管理人的业绩报酬 1、业绩报酬的计提原则及提取频率 （1）本集合计划将在两种情况下计提业绩报酬：

①是投资者申请退出（含临时开放期的退出及违约退出）或本集合计划终止清算时提取；②是收益分配时提取； （2）按份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬； （3）当投资者申请退出或本集合计划终止清算时，业绩报酬从投资者退出或清算金额中扣除；收益分配时，业绩报酬从投资者收益分配金额中扣除，收益分配金额应当覆盖业绩报酬； （4）份额持有人退出或本集合计划终止时，业绩报酬对应按照份额持有人退出份额和本集合计划终止时持有份额计算。如退出份额为某一笔持仓份额的一部分，则该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔剩余份额不受影响； （5）业绩报酬提取应当与集合计划的存续期限、收益分配和投资运作特征相匹配，从收益分配金额中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。 2、业绩报酬的计算方法及计提比例 在业绩报酬计提日，管理人计算上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，若年化收益率 R 小于或等于 r，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率 R 大于 r，则管理人对超出部分按 60% 的比例提取业绩报酬，于支付日由管理人出具划款指令给	①是投资者申请退出（含临时开放期的退出及违约退出）或本集合计划终止清算时提取；②是收益分配时提取； （2）投资者分多笔参与本集合计划的，按投资者每笔参与份额分别计提业绩报酬； （3）当投资者申请退出或本集合计划终止清算时，业绩报酬从投资者退出或清算金额中扣除；收益分配时，业绩报酬从投资者收益分配金额中扣除，并以收益分配金额为上限； （4）份额持有人退出或本集合计划终止时，业绩报酬对应按照份额持有人退出份额和本集合计划终止时持有份额计算。如退出份额为某一笔持仓份额的一部分，则该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔剩余份额不受影响； （5）业绩报酬提取应当与集合计划的存续期限、收益分配和投资运作特征相匹配，从收益分配金额中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。 （6）如投资者在持有本集合计划份额期间存在多个业绩报酬计提基准周期的，则管理人以每个业绩报酬计提基准周期各自对应的年化收益率计算业绩报酬金额，并按照实际值累加计算，作为管理人可实际计提的业绩报酬金额。 业绩报酬计提基准周期：①每笔份
---	---

托管人，由托管人根据划款指令支付。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0^* \times D}$$

R 为年化收益率； P_1^* 为业绩报酬计提日前一日的累计单位净值； P_0^* 为上一个业绩报酬计提日前一日的累计单位净值（若不存在则取份额确认日前一日的累计单位净值）； P_0 为上一个业绩报酬计提日前一日的单位净值（若不存在则取份额确认日前一日的单位净值）； D 为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（清盘计提业绩报酬时， D 为上一个业绩报酬计提日到集合计划终止日的年限，若上一个业绩报酬计提日不存在则取份额确认日）。

管理人业绩报酬计提公式如下：

收 益率 (R)	计 提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq r$	0	0
$R > r$	60 %	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

其中：

- (1) I 为管理人应提的业绩报酬；
- (2) A 为对应份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额；

额上一个业绩报酬计提日（如不存在，则为份额确认日）至第 1 个业绩报酬计提基准变更生效日；②第 1 个业绩报酬计提基准变更生效日至第 2 个业绩报酬计提基准变更生效日；③第 2 个业绩报酬计提基准变更生效日至第 n 个业绩报酬计提基准变更生效日；④第 n 个业绩报酬计提基准变更生效日至下一个业绩报酬计提日（终止清算时，业绩报酬计提日为集合计划清算日），依此类推。

2、业绩报酬的计算方法及计提比例

在业绩报酬计提日，管理人计算每一个业绩报酬计提基准周期的年化收益率 R ，并针对 R 减去对应业绩报酬计提基准周期的计提基准（ r ）的结果按照 60%的比例计算该周期的业绩报酬。投资者该笔参与份额在每个业绩报酬计提基准周期内的业绩报酬金额进行累加计算，作为管理人可实际计提的业绩报酬，于支付日由管理人出具划款指令给托管人，由托管人根据划款指令支付。如投资者该笔参与份额在全部的业绩报酬计提基准周期内经累加后的业绩报酬金额小于或等于 0 的，则不收取该投资者该笔份额业绩报酬。

每一个业绩报酬计提基准周期内的年化收益率的计算公式如下：

(3)D 为上—个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限(清盘计提业绩报酬时，D 为上—个业绩报酬计提日到集合计划终止日的年限；若上—个业绩报酬计提日不存在则取份额确认日)；

(4)r 为管理人业绩报酬计提的计提基准，具体以管理人在其指定网站发布销售公告、开放期公告或业绩报酬计提基准变更公告等公告为准。

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0 \times D}$$

R 为期间年化收益率。

P_1^* 为投资者每个业绩报酬计提基准周期期末日前一日的累计净值。

P_0^* 为投资者每个业绩报酬计提基准周期期初日前一日的累计净值。

P_0 投资者每个业绩报酬计提基准周期期初日前一日的单位净值。

D 为每个业绩报酬计提基准周期期初日到期末日的年限(终止清算计提业绩报酬时，D 为每个业绩报酬计提基准周期期初日到集合计划终止日的年限)。

每一个业绩报酬计提基准周期的管理人业绩报酬计算公式如下：

收 益率 (R)	计 提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq r$	60 %	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$
$R > r$	60 %	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

其中：

I 为单笔份额对应的单个业绩报酬计提基准周期内的管理人业绩报酬；

A 为投资者每个业绩报酬计提基准周期的期初日的资产净值总额；

	D 为每个业绩报酬计提基准周期期初日到期末日的年限（清盘计提业绩报酬时，D 为业绩报酬计提基准周期期初日到集合计划终止日的年限）； r 为管理人业绩报酬计提的计提基准，具体以管理人在其指定网站发布销售公告、开放期公告或业绩报酬计提基准变更公告等公告为准。 将该笔份额持有期内不同业绩报酬计提基准周期内的管理人业绩报酬加总，得到该笔份额的管理人可实际计提的业绩报酬（ΣI）： $\Sigma I = \text{MAX}(I_1 + I_2 + I_3 + \dots + I_n, 0)$ 其中的 n 为每笔份额所对应的不同业绩报酬计提基准周期的数量。
--	---

7、对原合同第二十三章“信息披露与报告”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（二）临时报告 4、集合计划 T 日收市后单位净值小于等于集合计划预警线（管理人应在计算出该净值并与托管人核对一致后的一个工作日内进行披露预警）；	（二）临时报告 4、集合计划存续期内任何一个交易日（T 日）日终，集合计划单位净值等于或低于预警线，同时当且仅当 T-1 日本集合计划单位净值高于预警线（管理人将于 T+1 日内以管理人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和投资者认可的方式进行信息披露，持续等于或低于预警线管理人将不再另行披露）

8、对原合同第二十四章“风险揭示”之“（二）一般风险揭示”中的表述

作如下变更：

原表述：	现表述：
26、预警线和止损线风控措施的风险 （1）本集合计划份额净值等于或低于预警线时，管理人将调整投资组合，并可能限制本集合计划投资操作的灵活性，直接影响本集合计划的收益水平。 （2）本集合计划份额净值等于或低于止损线时，管理人将进行强制止损，执行平仓变现操作。止损线的设置本身是一种风险控制手段，但平仓操作的执行效果与所持有品种的流动性及平仓时所处的市场环境等因素有关，既可能出现存在平仓不能及时完成、本集合计划份额净值进一步下跌的可能，也可能出现因流动性等原因，平仓价格不理想导致本集合计划财产损失的可能性。	26、预警止损机制的风险 为保护投资者的利益，本集合计划设置预警、止损机制。本集合计划预警线和止损线的设置并不是管理人对投资者所能获得的集合计划最低单位净值的保证。本集合计划份额净值等于或低于止损线时，管理人将进行强制止损，执行平仓变现操作。止损线的设置本身是一种风险控制手段，但平仓操作的执行效果与所持有品种的流动性及平仓时所处的市场环境等因素有关，既可能出现存在平仓不能及时完成、本集合计划份额净值进一步下跌的可能，也可能出现因流动性等原因，平仓价格不理想导致本集合计划财产损失的可能性。

9、对原合同第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”之“（二）集合计划的展期”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
4、投资者不同意展期的处理办法 若投资者不同意展期，投资者有权按照管理人展期公告，在存续期届满日前（含届满日）的指定时间内到销售机构申请退出其持有的全部集合计划份额，若投资者未在指定时间内到销售机	4、投资者不同意展期的处理办法 若投资者不同意展期的，有权按照管理人展期公告，在存续期届满日前（含届满日）的指定期限内申请退出其持有的全部集合计划份额，管理人应为其办理退出手续；若投资者未在指定期

构申请退出其持有的全部集合计划份额，则视为同意展期，管理人不再另行通知确认。	限内到销售机构申请退出其持有的全部集合计划份额，管理人有权在指定的期限交易时间届满后将相关份额强制退出本集合计划。
--	---

10、对原合同第二十八章“资产管理合同的效力”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）资产管理合同签署的方式 资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函、网站公告征求意见等形式对本合同的有效修订和补充）可采用电子或纸质方式签订，中国证券投资基金业协会另有规定的从其规定。管理人、托管人作为资产管理合同签署方，已接受资产管理合同项下的全部条款。 投资者作为资产管理合同一方，以纸质或电子方式签署资产管理合同即表明投资者完全接受资产管理合同项下的全部条款。采用电子方式时，投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定。三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子方式签订资产管理合同、风险揭示书或其他文书的，视为签署资产管理合同、风险揭示书或其他文书，与在纸质资产管理合同、纸质风险揭示书或其他纸质	（一）资产管理合同签署的方式 资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函、网站公告征求意见等形式对本合同的有效修订和补充）可采用电子或纸质方式签订，中国证券投资基金业协会另有规定的从其规定。管理人、托管人作为资产管理合同签署方，已接受资产管理合同项下的全部条款。 投资者作为资产管理合同一方，以纸质或电子方式签署资产管理合同即表明投资者完全接受资产管理合同项下的全部条款。采用电子方式时，投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定。三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子方式签订资产管理合同、风险揭示书或其他文书的，视为签署资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本合同的有效修订和

文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质资产管理合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书。	补充）、风险揭示书或其他文书，与在纸质资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本合同的有效修订和补充）、纸质风险揭示书或其他纸质文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质资产管理合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书。
---	---

二、变更方案的安排

现将投资者如何参与本集合计划合同变更相关事宜说明如下：

1、本次合同变更期间（即征询期间）为：自合同变更相关安排的公告发布之日起到2024年10月17日（含）止。

2、投资者不同意本次合同变更的，应当在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部本集合计划份额，对于提出退出申请的投资者，管理人将按照正常退出申请流程进行退出份额确认。

3、投资者在管理人指定的期限内未申请退出其持有的全部本集合计划份额的，视为投资者同意本次合同变更。

特别提示：2024年10月17日：投资者提出的退出申请可不受锁定期限制。

本次合同变更自管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效，否则将另行通知，对合同各方均具有法律效力。

感谢您的支持与配合！如有疑问，可咨询申港证券股份有限公司。



